

**CEARAPREV**  
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA  
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



**CEARÁ**  
GOVERNO DO ESTADO  
SECRETARIA DO  
PLANEJAMENTO E GESTÃO

## RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# FUNAPREV

Período: dezembro de 2020

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Posição de Ativos e Enquadramento**

**RENDA FIXA** **100,00%**

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,28	3,63	96.310.740,00	100,00	16.753.976.831,37	0,57
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,55</b>	<b>0,28</b>	<b>3,63</b>	<b>96.310.740,00</b>	<b>100,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,55</b>	<b>0,28</b>	<b>3,61</b>	<b>96.310.740,00</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>0,55</b>	<b>0,28</b>	<b>3,63</b>	<b>96.310.740,00</b>	<b>100,00</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Enquadramento da Carteira**

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	96.310.740,00	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>96.310.740,00</b>	<b>100,00</b>					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/12/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,28 173,14	3,63 131,20	0,64 136,66	1,12 113,38	3,63 131,20	355.935,25	3.860.862,12
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>355.935,25</b>	<b>3.860.862,12</b>

### RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	49.677.699,42	276.054.619,30	-229.777.513,97	0,00	96.310.740,00	355.935,25	3.860.862,12
					96.310.740,00	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

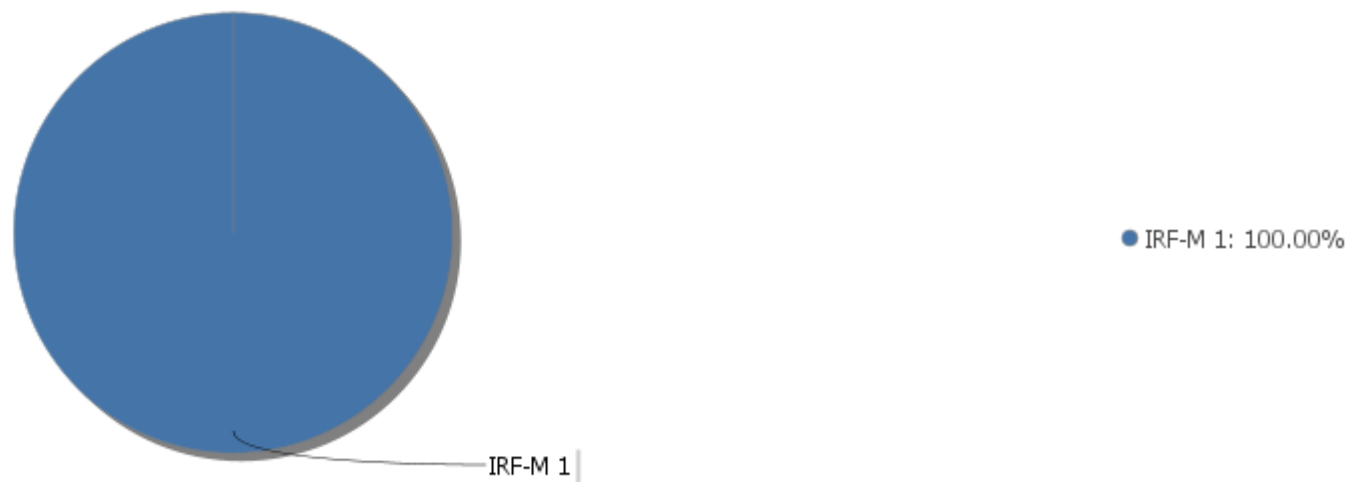
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	96.310.740,00	100,00	96.310.740,00	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	96.310.740,00	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	96.310.740,00	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

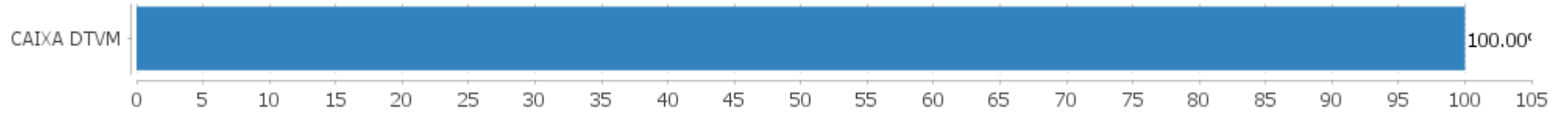


### Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2020	0,42	0,36	0,59	0,43	0,39	0,26	0,24	0,10	0,13	0,14	0,22	0,28	3,63
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55	0,95	1,17	1,19	1,68	8,42
p.p. indexador	-0,11	-0,15	0,20	0,45	0,48	-0,31	-0,46	-0,45	-0,82	-1,03	-0,97	-1,39	-4,79

### Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	3	25,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	9	75,00

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	0,10	2020-08

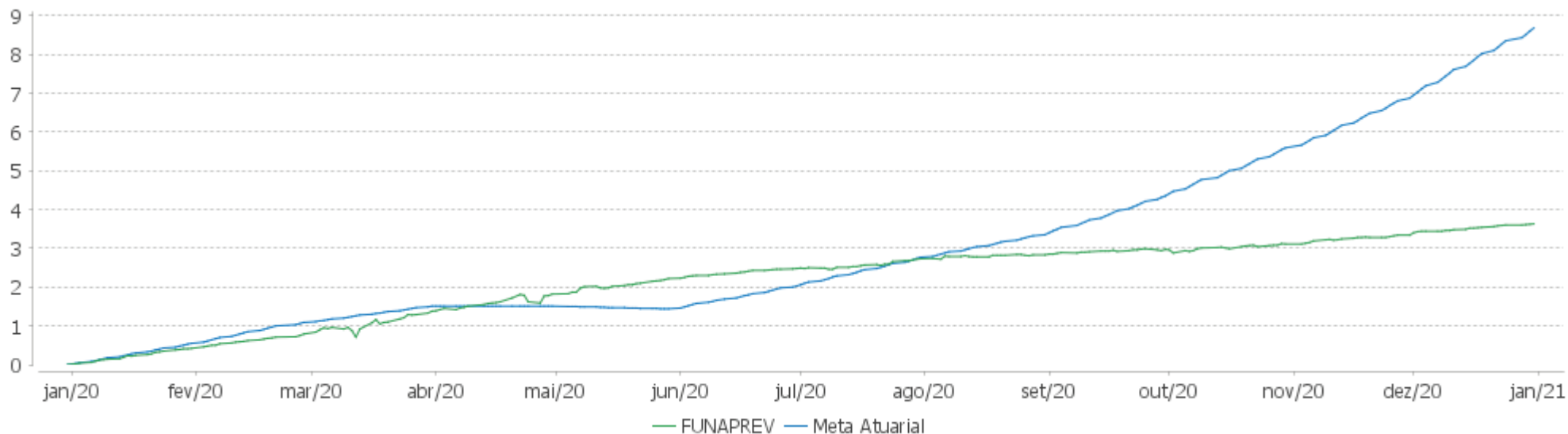
### Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,64	4,08	-3,44	0,34
06 meses	1,12	6,39	-5,27	0,32
12 meses	3,63	8,42	-4,79	0,55
24 meses				
Desde 31/12/2019	3,63	8,42	-4,79	0,55

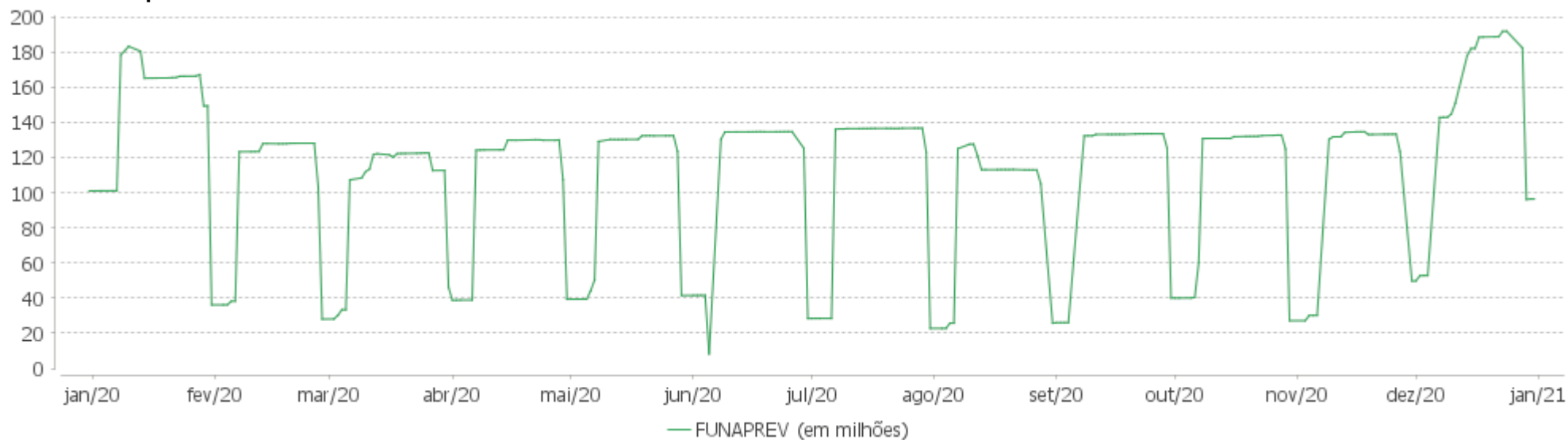


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

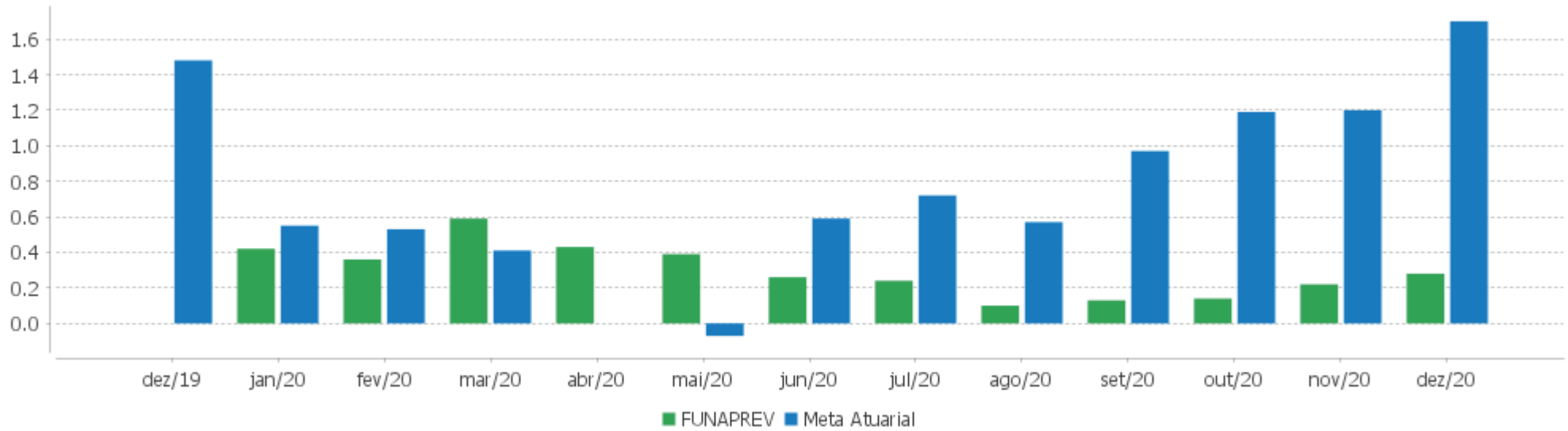


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,28 -0,03	3,63 -0,21	0,64 -0,06	1,12 -0,09	3,63 -0,21	10,42 -0,44	17,94 -0,66
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,28 -1,39	3,63 -4,79	0,64 -3,44	1,12 -5,27	3,63 -4,79		
CDI	0,16	2,77	0,47	0,99	2,77	8,90	15,90
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6,00%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6,00%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/12/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indexadores**

**Renda Fixa**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,31	3,84	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59	31,78	51,17
IRF-M 1+	3,05	8,45	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09	62,28	110,38
IRF-M TOTAL	1,95	6,69	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36	52,47	88,11
IMA-B 5	1,83	8,04	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31	51,20	74,61
IMA-B 5+	7,51	5,50	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72	78,96	134,51
IMA-B TOTAL	4,85	6,41	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91	66,83	108,23
IMA-GERAL TOTAL	2,02	5,34	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77	47,53	78,50
IDKA 2	1,73	8,62	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31	51,45	74,50
IDKA 20	11,36	2,20	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53	99,14	205,07
CDI	0,16	2,77	0,47	0,99	2,77	8,90	15,90	27,43	45,27

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78	97,61	174,56
IBRX 100	9,15	3,50	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35	103,24	177,83
IBRX 50	9,42	3,62	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28	94,38	165,96
SMALL CAP	7,52	-0,65	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94	153,81	234,41
IFIX	2,19	-10,24	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91	53,93	103,70
Índice Consumo - ICON	5,00	0,81	11,11	13,14	0,81	56,51	41,53	88,43	113,36
Índice Dividendos - IDIV	8,94	-1,00	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63	108,79	235,09

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,35	4,52	3,13	4,42	4,52	9,02	13,10	16,43	23,76
INPC	1,46	5,45	3,34	5,07	5,45	10,17	13,96	16,31	23,97
IGPM	0,96	23,14	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09	41,35	51,49
SELIC	0,16	2,77	0,47	0,99	2,77	8,90	15,90	27,45	45,32

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	1,09	49,89	2,90	14,97	49,89	100,95	120,70	167,51	144,57
MSCI ACWI	1,88	47,41	5,35	16,84	47,41	90,22	97,90	144,28	115,36

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,70	8,68	4,15	6,52	8,68	17,91	27,18	36,11	50,43
IPCA + 5,00%	1,78	9,72	4,40	7,03	9,72	20,19	30,88	41,39	57,76
IPCA + 5,50%	1,82	10,24	4,52	7,29	10,24	21,34	32,75	44,09	61,54
IPCA + 5,89%	1,86	10,65	4,62	7,49	10,65	22,24	34,23	46,22	64,53
IPCA + 6,00%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64	46,83	65,38
INPC + 4,00%	1,81	9,65	4,35	7,18	9,65	19,16	28,15	35,96	50,68
INPC + 6,00%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66	46,67	65,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
519	01/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.127,59448100	2,6070720000
530	02/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.949.138,03	0,00	1.130.878,60822100	2,6078290000
550	02/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.580,92	7.508,51341300	2,6078290000
520	03/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.443,98	0,00	12.055,81627100	2,6082000000
531	03/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	85.438,77	0,00	32.757,75247200	2,6082000000
532	04/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.868,68	0,00	1.099,91223400	2,6080990000
533	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	122.179.589,60	0,00	46.843.691,37809400	2,6082400000
551	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.459.514,88	14.361.989,26522300	2,6082400000
559	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.177.900,84	0,00	1.985.208,73845900	2,6082400000
521	08/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	125.106,20	0,00	47.965,42366500	2,6082580000
534	08/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.416,67	0,00	926,54561000	2,6082580000
552	08/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	35.838,90	13.740,55013900	2,6082580000
522	09/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.409,84	0,00	16.641,01056200	2,6086060000
523	10/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.167,03	0,00	17.697,02673100	2,6087450000
535	10/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.813.315,60	0,00	2.611.721,57493300	2,6087450000
553	10/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.007.377,01	1.919.458,20833300	2,6087450000
536	11/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.153.798,78	0,00	2.358.452,31566200	2,6092530000
537	14/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	78.976.105,69	0,00	30.266.419,59113400	2,6093640000
538	14/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	364.950,87	0,00	139.862,00085500	2,6093640000
554	14/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	52.356.448,57	20.064.831,33748600	2,6093640006
524	15/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.087,98	0,00	9.994,80107500	2,6101550000
539	15/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.587.717,08	0,00	5.205.712,71821000	2,6101550000
555	15/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.590.978,24	3.674.486,08694900	2,6101550000
540	16/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.900,47	0,00	3.026,65210800	2,6103000000
541	17/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.332.862,62	0,00	7.788.709,61588200	2,6105560000
556	17/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.976.483,74	5.353.834,10047000	2,6105560000
525	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.420,25	0,00	10.502,45074100	2,6108430000
542	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	61.501,99	0,00	23.556,37240500	2,6108430000

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
526	21/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	100.988,19	0,00	38.676,34454300	2,6111100000
543	21/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.176,05	0,00	833,38120500	2,6111100000
544	22/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.393.042,43	0,00	3.596.542,16986900	2,6116870000
549	22/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.209.994,07	1.611.982,63188700	2,6116869914
560	22/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.184.743,85	1.985.208,73845900	2,6116870000
527	23/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.422,90	0,00	2.076,09926500	2,6120620000
545	23/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.045.350,02	0,00	1.165.879,68432600	2,6120620000
528	24/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.244,10	0,00	11.577,85453600	2,6122370000
546	28/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.886,15	0,00	11.058,16089200	2,6122020000
557	28/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.528.949,90	3.647.861,03612500	2,6122020000
529	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.212,80	0,00	17.688,66317600	2,6125660000
547	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.137.284,17	0,00	2.349.140,33559300	2,6125660000
558	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	92.407.603,89	35.370.438,06121300	2,6125660000
548	30/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	266.931,80	0,00	102.161,51690800	2,6128410000
<b>Total</b>			<b>276.054.619,30</b>	<b>229.777.513,97</b>		



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/12/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 148.826,28

Value-At-Risk: 0,15%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,15	0,15			96.310.740,00	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,15%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,15	0,15	0,02			96.310.740,00	100,00
<b>Sub-total</b>	0,21	0,15	0,15		0,58	0,28	96.310.740,00	100,00